

DAFTAR ISI

ABSTRAK	i
ABSTRACT	ii
LEMBAR PENGESAHAN	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS	iv
LEMBAR PERNYATAAN PERSETUJUAN PUBLIKASI KARYA ILMIAH UNTUK KEPENTINGAN AKADEMIS	v
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR GAMBAR	xi
BAB I PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Masalah.....	1
B. Perumusan Masalah	8
C. Tujuan Penelitian	9
D. Manfaat Penelitian	9
1. Manfaat Bagi Teoritis.....	9
2. Manfaat Bagi Praktisi.....	10
BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS..	11
A. Kajian Pustaka.....	11
1. <i>Signaling Theory</i>	11
2. <i>Return Saham</i>	13
3. Kinerja Keuangan.....	14
4. <i>Return On Asset (ROA)</i>	16
5. <i>Economic Value Added (EVA)</i>	19
B. Hasil Penelitian Yang Relevan.....	23
C. Kerangka Teoritik	31
1. Pengaruh EVA terhadap <i>Return Saham</i>	31
2. Pengaruh ROA terhadap <i>Return Saham</i>	32
3. Perumusan Hipotesis	33

BAB III METODOLOGI PENELITIAN.....	34
A. Objek dan Ruang Lingkup Penelitian	34
B. Metode Penelitian.....	34
C. Operasional Variabel Penelitian.....	35
1. Variabel Terikat (<i>Dependent Variable</i>).....	35
2. Variabel Bebas (<i>Independent Variable</i>).....	35
D. Metode Pengumpulan Data	38
E. Populasi dan Sampel	38
F. Metode Analisis	41
1. Statistik Deskriptif.....	41
2. Analisis Regresi Model Data Panel	42
3. Pendekatan Model Estimasi	43
4. Uji Asumsi Klasik	44
5. Pengujian Hipotesis (Uji t-statistik)	44
6. Koefisien Determinasi (R^2)	45
BAB IV PEMBAHASAN.....	47
A. Statistik Deskriptif	47
B. Hasil Uji Model Regresi Data Panel	53
C. Hasil Uji Asumsi Klasik.....	55
D. Hasil Uji Regresi dan Pembahasan	56
E. Hasil Uji Hipotesis	57
1. Pengaruh EVA terhadap <i>return</i> saham.....	57
2. Pengaruh ROA terhadap <i>return</i> saham.....	59
F. Koefisien Determinasi.....	60
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	62
A. Kesimpulan	62
B. Implikasi.....	69
C. Saran.....	69
DAFTAR PUSTAKA	65
LAMPIRAN 1	69
LAMPIRAN 2.....	73

DAFTAR TABEL

Tabel	Judul	Halaman
I.1	Saham <i>Top Gainers</i>	3
II.1	Penelitian Terdahulu <i>Return Saham</i>	30
III.1	Operasionalisasi Variabel Penelitian.....	32
III.2	Kriteria Perusahaan.....	35
III.3	Daftar Perusahaan.....	36
IV.1	Statistik Deskriptif.....	43
IV.2	Uji Chow.....	49
IV.3	Uji Multikolinetiras.....	50
IV.4	Hasil Uji Regresi Data Panel Return Saham Common Effect Model.....	51

DAFTAR GAMBAR

Gambar	Judul	Halaman
II.1	Kerangka Teoritik.....	33
IV.1	Rata-Rata <i>Return</i> Saham Per Tahun.....	44
IV.2	Rata-Rata EVA Per Tahun.....	46
IV.3	Rata-Rata ROA Per Tahun.....	47